

# 华夏理财天工日开理财产品 2 号（数字基础设施指数）

## 2023 年第 4 季度报告

### 重要信息提示：

- 1、理财非存款，产品有风险，投资须谨慎。理财产品过往业绩不代表其未来表现，不等于理财产品实际收益。
- 2、华夏理财有限责任公司保留对所有文字说明的最终解释权。

产品管理人：华夏理财有限责任公司

产品托管人：华夏银行股份有限公司

报 告 期：2023 年 10 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

## 第一章 基本信息

|         |                            |
|---------|----------------------------|
| 产品名称    | 华夏理财天工日开理财产品 2 号（数字基础设施指数） |
| 理财产品代码  | 23802002                   |
| 产品登记编码  | Z7003923000231             |
| 产品募集方式  | 公募                         |
| 产品运作模式  | 开放式                        |
| 产品投资性质  | 权益类                        |
| 投资及收益币种 | 人民币                        |
| 产品风险评级  | PR5 级（高风险）                 |
| 杠杆水平    | 100.40%                    |
| 产品起始日期  | 2023-07-21                 |
| 产品终止日期  | 无特定存续期限                    |

## 第二章 净值、存续规模及收益表现

| 估值日期       | 份额净值<br>(元) | 份额总数 (份)     | 累计净值<br>(元) | 资产净值 (元)     | 期间累计净<br>值增长率 |
|------------|-------------|--------------|-------------|--------------|---------------|
| 2023-12-31 | 0.9621      | 1,971,004.28 | 0.9621      | 1,896,222.27 | -1.37%        |
| 2023-09-30 | 0.9755      | 2,020,030.64 | 0.9755      | 1,970,577.01 |               |

注：期间累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初份额净值\*100%

## 第三章 资产持仓

### 3.1 期末产品资产持仓情况

| 序号 | 资产类别          | 穿透前占总资产比例 | 穿透后占总资产比例 |
|----|---------------|-----------|-----------|
| 1  | 现金及银行存款       | 0.01%     | 6.43%     |
| 2  | 同业存单          | 0.00%     | 0.00%     |
| 3  | 拆放同业及债券买入返售   | 0.00%     | 0.00%     |
| 4  | 债券            | 0.00%     | 0.00%     |
| 5  | 非标准化债权类资产     | 0.00%     | 0.00%     |
| 6  | 权益类投资         | 0.00%     | 93.57%    |
| 7  | 金融衍生品         | 0.00%     | 0.00%     |
| 8  | 代客境外理财投资 QDII | 0.00%     | 0.00%     |
| 9  | 商品类资产         | 0.00%     | 0.00%     |
| 10 | 另类资产          | 0.00%     | 0.00%     |
| 11 | 公募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 12 | 私募基金          | 0.00%     | 0.00%     |
| 13 | 资产管理产品        | 99.99%    | 0.00%     |
| 14 | 委外投资——协议方式    | 0.00%     | 0.00%     |

注：由于计算中四舍五入的原因，占总资产的比例可能存在尾差；“权益类投资”类别中包含优先股。

### 3.2 期末产品持有的前十项资产

| 序号 | 资产名称         | 资产类别    | 持有金额<br>(元) | 占总资产<br>的比例 |
|----|--------------|---------|-------------|-------------|
| 1  | 中国移动         | 权益类投资   | 165,204.11  | 8.68%       |
| 2  | 中国电信         | 权益类投资   | 162,099.92  | 8.51%       |
| 3  | 中国电信         | 权益类投资   | 162,076.06  | 8.51%       |
| 4  | 电讯盈科         | 权益类投资   | 160,269.91  | 8.42%       |
| 5  | 中国移动         | 权益类投资   | 156,032.01  | 8.20%       |
| 6  | 中国铁塔         | 权益类投资   | 155,983.85  | 8.19%       |
| 7  | 中国联通         | 权益类投资   | 155,949.49  | 8.19%       |
| 8  | 中国联通         | 权益类投资   | 153,383.32  | 8.06%       |
| 9  | 存款及清算款等现金类资产 | 现金及银行存款 | 122,365.69  | 6.43%       |
| 10 | 宝信软件         | 权益类投资   | 55,107.89   | 2.89%       |

### 3.3 期末产品持有的非标准化债权类资产

| 序号 | 融资客户 | 项目名称 | 交易结构 | 收益率<br>(%) | 剩余期限<br>(天) | 风险状况 |
|----|------|------|------|------------|-------------|------|
| -  | -    | -    | -    | -          | -           | -    |

### 3.4 报告期内关联交易情况

#### 3.4.1 报告期内投资关联方发行的证券的情况

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 投资规模（元） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 3.4.2 报告期内投资关联方承销的证券的情况

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 投资规模（元） |
|-------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -       |

#### 3.4.3 报告期内其他关联交易

| 关联方名称 | 资产代码 | 资产名称 | 交易类型 | 投资规模（元） |
|-------|------|------|------|---------|
| -     | -    | -    | -    | -       |

#### 第四章 收益分配情况

| 除权日期 | 每万份理财份额分红数（元） |
|------|---------------|
| -    | -             |

## 第五章 风险分析

### 5.1 投资组合流动性风险分析

本产品为被动指数类产品，投资资产主要为跟踪指数标的成分股。资产均为具有良好流动性的股票及现金管理工具。四季度末，产品持有的股票市值占持有股票的自由流通市值合计的比例如下表。

| 产品名称                     | 产品持有股票市值<br>(亿元) | 持有股票的自由流通<br>市值合计(亿元) | 占比      |
|--------------------------|------------------|-----------------------|---------|
| 华夏理财天工日开理财产品2号(数字基础设施指数) | 0.02             | 9823.86               | 0.0002% |

可见投资组合持有股票资产可满足极端情况下的流动性变现要求。投资组合每日现金类资产占比不低于5%，可满足日常的申赎需求。综上，投资组合流动性风险可控。

### 5.2 投资组合投资风险分析

#### 5.2.1 产品债券持仓风险及价格波动情况

本产品无债券持仓。

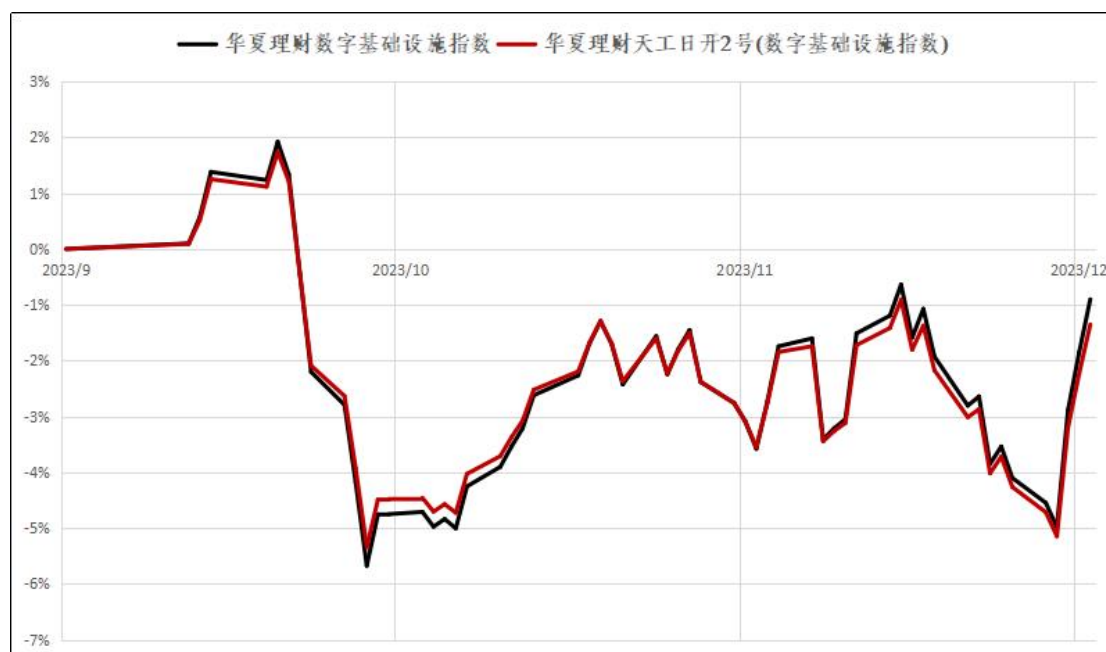
#### 5.2.2 产品权益持仓风险及价格波动情况

本产品为被动指数类产品，权益持仓采用全复制方式跟踪相应指数标的，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。四季度产品未发生因特殊原因（具体情形详见产品说明书）导致无法有效复制和跟踪标的指数的情况。

产品四季度权益持仓价格波动较大的标的如下表，四季度的区间涨跌幅均在正常波动范围内。

| 代码        | 名称   | 区间涨跌幅  |
|-----------|------|--------|
| 688041.SH | 海光信息 | 31.5%  |
| 0008.HK   | 电讯盈科 | 16.5%  |
| 688123.SH | 聚辰股份 | 11.0%  |
| 000977.SZ | 浪潮信息 | -11.7% |
| 0762.HK   | 中国联通 | -13.7% |

产品四季度净值涨跌幅为-1.37%，跟踪标的华夏理财数字基础设施指数涨跌幅为-0.90%，产品与跟踪标的指数涨跌幅差异较小。



### 5.2.3 产品衍生品持仓风险及公允价值变动情况

本产品无衍生品持仓。

## 第六章 投资账户信息

| 序号 | 账户类型 | 账户编号              |
|----|------|-------------------|
| 1  | 托管账户 | 10257000000940053 |

## **第七章 影响投资者决策的其他重要信息**

无影响投资者决策的其他重要信息。